

REFERENCE & PURPOSE			Method/ Result		VARIABLES		DATA		CONCLUSION	COMMENTS	
Author(s), Title, Journal	Year Published	Purpose	Method	Result	Y	X	Used data	Year Data Collected			
Hall, Aaron Smalter. "Machine learning approaches to macroeconomic forecasting." The Federal Reserve Bank	2018	실업률 예측에서의 전통적 기법( consensus, statistical forecast) vs Machine Learning ( elastic net )	Elastic Net을 사용하였으며, 기존에 자주사용되는 AR, Randomwalk, 블루칩기법과 비교하는 형태로 진행 ( 복잡한 통계기	control of model complexity through regularization을 통해 적절한 모델을 산출가능하였고, consensus나 간단한 통계기법	Unemployment (현재시점 t까지 관측된 데이터 모두를 이용하여 t+1의 데이터를 예측한다. ( FRED-MD 실업률 데이터 사	(McCracken and Serena Ng 2015) 의 138개 거시경제 데이터 사용 + 1959~2017의 데이터 사용	FRED의 거시경제 데이터 ( McCracken and Serena Ng 2015 )	1959-2017	control of model complexity through regularization을 통해 적절한 모델을 산출가능하였고, consensus나 간단한 통계기법	예시	
뉴스와 주가 : 빅 데이터 감성분석을 통한 지능형 투자의 사결정모형	2012	본 연구는 뉴스들을 수집·분석하여 주가(코스피, 개별종목 아님)와 어떠한 관련이 있는지 분석하였다.	오피니언 마이닝 : 뉴스 콘텐츠를 분석, 지능형 투자의사결정 모형 : 주가지수의 등락을 예측	뉴스 콘텐츠의 감성분석 결과 값과 주가지수 등락과는 유의한 관계를 가지고 있었으며, 좀 더 세부적으로는 주식시장 개장 전 뉴스들과 주가지수의 등			본 연구를 위해 한국거래소에서 2011년 7월부터 9월까지 3개월간 주식시장이 개장된 63일의 KOSPI 지수와 지수등락폭을 수집하였고, 뉴스 데이터는 포	2011.07~ 09 3개월간	긍정부정이 영향을 미침 < 단순 긍정부정보다 이의 비율이 더 정확 // 뉴스 유형에 따라 주식시장에 미치는 영향이 다름 // 뉴스의 긍정/부정 의견과 주	뉴스의 내용뿐만 아니라 매체, 시간, 뉴스 유형 등 다양한 정보들을 수집·분류하여 투자의사결정을 추할 수 있는 변	
Trade the tweet: Social media text mining and sparse matrix factorization for stock market prediction	2016	텍스트정보 (user-generated microblogs)(감정분석 사용안함)를 주식시장 예측에 활용 , we correlate the movements of both stock price and	핵심기법 : sparse matrix factorization proposed by Wong et al. (2014)를 사용 //We utilize the R library tm to carry out the preprocessing				majority of stocks listed in the S&P 500 Index( Y변수 ) , We obtained approximately 45 million messages from	2011 to 2015	(1) 뉴스가 아닌 대용량 sns데이터를 사용 (2) 감정분석을 사용하지 않음	감성분석을 사용하지 않고, buy short sell 등과 같은 단어의 언급빈도만 카운트 하여 행렬안에 넣어 X변수로 사용	
Text mining for market prediction: A systematic review	2014	텍스트 마이닝 - market predict와 관련된 여러 논문 리뷰	시트 2								

Can a Corporate Network and News Sentiment Improve Portfolio Optimization Using the Black Litterman Model?	2015	투자자의 기댓값을 데이터 빈도와 회계변수 조합을 기반으로 설정하는 방법을 제안함; ; financial analysts' recommendations, and corporate social network indicators with quarterly data	머신러닝 기법 (AdaBoost, CART)과 링크 마이닝, 자동화한 텍스트 마이닝 기법을 가지고 BL 포트폴리오를 구성하는 방법을 사용한다.				quarterly data of social networks and fundamental indicators as investors' view	<p>1. Social networks 그리고 investor view(indicator)을 이용한 modified BL portfolio는 market portfolio를 능가했다.</p> <p>2. 뉴스 감정 분석은 한 종목 기댓값에 큰 영향을 준다는 결과로, modified BL portfolio의 investor view(indicator)로 사용할 수 있었다. 실제 시뮬레이션으로 뉴스 감정 분석을 사용한 portfolio가 market portfolio와 market index를 능가했다.</p>	
--	------	--	---	--	--	--	---	---	--



